

2017年年度报告摘要

- 86 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未有债券投资。
- 87 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未有资产支持证券投资。
- 88 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未有贵金属投资。
- 89 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未有权证投资。
- 90 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 91 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金投资于股指期货的投资政策

8.12 报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

8.13 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

8.14 报告期内国债期货投资政策

报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

8.15 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资,无期间损益。

8.16 本期国债期货投资评价

报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

8.17 投资组合报告附注

8.12 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内因公开违法、违规行为的情形。

8.13 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.13.1 期末其他各项资产构成

项 目	金 额
存出保证金	99,597.63
应收证券清算款	179,178.08
应收股利	-
应收利息	-18,433.38
应收申购款	22,160.65
其他应收款	-
待摊费用	-
其他	-
合计	322,033.46

单位:人民币元

8.2.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

基金单位:人民币元				
序号	股票代码	股票名称	基金投资部分公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	15,094,613.70	1.47
基金管理人: 季会开/开打				
§ 9 基金资产净值持有人信息				
截至 9 月 30 日基金净值持有人户数及持有内人结构				
			份额单位: 份	
基金类别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人持有内人	
			持有内人数量	占基金资产净值比例 (%)
基金类别: 股票型	41,853	19,904.10	729,246.54	0.09%
基金类别: 混合型			832,316,872.81	99.91%

长期待摊费用	0	0.00	0.00	0.00%	0.00	0.00%
--------	---	------	------	-------	------	-------

92	期末上市基金前十名持有者	7.45%	4.45%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
93	期末上市基金前二十名持有者	14.90%	8.90%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
94	期末上市基金前五十名持有者	24.80%	13.80%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%

公司高级管理人员、基金投资和研	工银稳健成长混合 A	0
	工银稳健成长混合 H	0

	合计	0	0
基金基金管理人有关开发基金	工银稳健成长混合A	0	0
	工银稳健成长混合H	0	0
	合计	0	0

§ 0 开放式基金份额变动

单位:份

项目	工银稳健成长混合A	工银稳健成长混合H
基金合同生效日(2009年12月6日)基金份额总额	12,229,368,670.28	-
报告期内基金份额总额	963,162,520.85	99,502.49
报告期末基金份额总额	25,198,522.78	-
本报告期末基金份额总额	175,272,426.43	99,502.49

報告期末資產負債總額	833,046,118.15	-
------------	----------------	---

[illegible]

涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

94基金投资策略的改变

报告期内，本基金管理人根据市场环境、政策变化、国家宏观经济形势的变化等，对基金的投资策略进行了适当的调整。

95与基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用为0元整。该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

96管理人、托管人及其高级管理人员受惩戒或处罚等情况

报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门或法院的处罚。

97基金租用证券公司交易单元的有关情况

98基金租用证券公司交易单元进行股票投资和支付佣金情况

金額單位：人民幣元

基金名称	交易币种名称	成交金额	占当期股票成交金额的比重	佣金	占当期佣金总额的比重	备注
东方保本	1	542,243,343.00	24.84%	331,474.18	2157%	-
华泰沪深300	2	439,331,146.62	20.32%	438,586.53	2659%	-
华泰沪深300	1	432,784,577.94	19.83%	394,361.39	1724%	-
华泰沪深300	1	427,495,222.73	19.55%	283,345.02	184%	-
华泰沪深300	1	235,067,067.87	10.81%	147,655.17	932%	-
华泰沪深300	2	32,821,114.31	1.55%	20,733.69	130%	-
华泰沪深300	1	30,323,829.71	1.39%	21,589.14	146%	-
安信沪深300	1	19,915,254.85	0.91%	18,146.03	11%	-
华泰沪深300	1	19,474,552.54	0.91%	18,137.55	11%	-
华泰沪深300	1	2,333,280.12	0.11%	2,172.61	0.14%	-
中央金	1	70,725.04	0.00%	6.67	0.00%	-

申万宏源	1	0	0	0	0	0
山能环能	1					

安信证券	1	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-

注：1. 评分的选择标准和程序

①选择标准，注重综合服务能力

②商务状况良好，经营行为规范，风险管理先进，投资风格与工银信託有互补性，在最近一年内无重大违规行为。

③券商具有较强的综合研究能力；能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析等各类丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据工银信託所管理基金的特定制要求，提供个性化、具有差异化投资视角和前瞻的能力以及其它综合服务能力。

q 与其他券商相比,该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

2. 合作研究的选定, 根据以上标准对参商进行考察、选择和确定。在合作之前, 参商须提供至少两个季度财务及其他已合作商一起参与投资研究部门(权益投资部, 固定收益部, 专户投资部, 研究和中央交易)两个季度对参商的研究服务评估。投委会将根据对参商研究服务评估结果决定是否作为新增合作。

3. 签订委托协议, 与被选定的参商签订委托代理协议, 明确定义协议双方的公司名称、委托代理期限、双方的权利义务等, 经签署生效。

2. 参商的评估、保留和更换程序

1) 单位的保留期限规定为一年, 合同到期 5 天内, 投研研究部门将根据各参商研究在服务期间的综合服务质量等进行评估, 进行评估。

2) 评估合格和不合格的参商均须与投研部门签订评估标准书和评估报告, 评估合格者, 根据参商评估

准和程序,重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构,租用其交易席位。

与券商提供的衍生品交易服务不符合要求,且衍生品合约按照利率协议定价,据此中途平仓其交易易

2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交金额的比例	成交金额	占当期债券回购成交金额的比例	成交金额	占当期权证成交金额的比例
东方证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	1,760,000.000.00	99.92%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华国证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	5,000,000.00	0.28%	-	-

恒信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	8,000,000.00	0.45%	-	-
北京海华	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	-	-	-	-
华万宝源	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广利源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

§ 2 影响投资者决策的其他重要信息

2.报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 2.1%的情况

22 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金管理人于 2019 年 5 月 31 日披露的《关于工银瑞信稳健成长混合型证券投资基金变更基金经理公告》，自 2019 年 5 月 27 日起，杨何先生不再担任工银瑞信稳健成长混合型证券投资基金的基金经理。